

Estimátory k-té třídy

[H.Theil 1962]

Rekursivní model je zvláštní (ne však výjimečná) forma ekonometrického modelu charakteristická tím, že :

- tvar matice **B** vztahů propojujících běžné endogenní proměnné odpovídá situaci, kdy vhodné seřazení modelových rovnic umožní zápis modelu ve tvaru, v němž běžná endogenní proměnná přítomná jako vysvětlující v uvažované rovnici může být vysvětlována pouze v některé z rovnic, které jí předchází

a současně kdy

- v matici Σ se nepřipouští korelace náhodných složek v různých rovnicích modelu (ani v témže čase).

Formálně vyjádřeno, v (ryze) rekursivním modelu platí restrikce:

a) matice B koeficientů příslušných běžným endogenním proměnným je dolní (resp. horní) **trojúhelníková**, tj. platí pro ni $\beta_{jk} = 0$ pro $j < k$

b) matice Σ kovarianční matice náhodných složek soustavy, pro niž platí $\text{Cov}(u_t, u_s) = \delta_{ts}$. Σ je **diagonální**. Připouští se tedy "heteroskedasticita", nikoliv "korelovanost" náhodných složek (v témže čase) v různých rovnicích .